

海富通中证500指数增强型证券投资基金(海富通中证500增强A) 基金产品资料概要更新

编制日期: 2023年12月14日

送出日期: 2023年12月22日

本概要提供本基金的重要信息,是招募说明书的一部分。作出投资决定前,请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	海富通中证 500 增强	基金代码	519034
下属基金简称	海富通中证 500 增强 A	下属基金代码	519034
基金管理人	海富通基金管理有限公司	基金托管人	中国建设银行股份有限公司
基金合同生效日	2020-03-05		
基金类型	股票型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	朱斌全	开始担任本基金基金经理的日期	2022-12-13
		证券从业日期	2007-04-02
	李自悟	开始担任本基金基金经理的日期	2023-02-15
		证券从业日期	2008-04-30
基金转型情况说明	海富通中证 500 指数增强型证券投资基金于 2020 年 3 月 5 日由海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金转型而来。海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2011]1801 号文核准募集,并于 2012 年 5 月 25 日生效。经中国证监会 2019 年 7 月 19 日《关于准予海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金变更注册的批复》,海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金就基金转型事宜进行变更注册,并自 2020 年 1 月 31 日至 2020 年 2 月 28 日以通讯方式召开基金份额持有人大会,大会获表决通过。自 2020 年 3 月 5 日起,《海富通中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》生效,原《海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金基金合同》自同日起失效。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资者可阅读本基金《招募说明书》“九、基金的投资”了解详细情况。

投资目标 本基金为增强型股票指数基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制,力求实现超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。

投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可投资于国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方

政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(包含可分离交易可转换债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金持有的股票资产及存托凭证占基金资产的比例为不低于80%,其中,投资标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

主要投资策略

本基金为增强型指数基金,在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数基础上通过数量化模型进行投资组合优化,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。

具体投资策略主要包括:1、资产配置策略;2、股票投资策略;3、股指期货投资策略;4、债券投资策略;5、国债期货投资策略;6、资产支持证券投资策略。

业绩比较基准

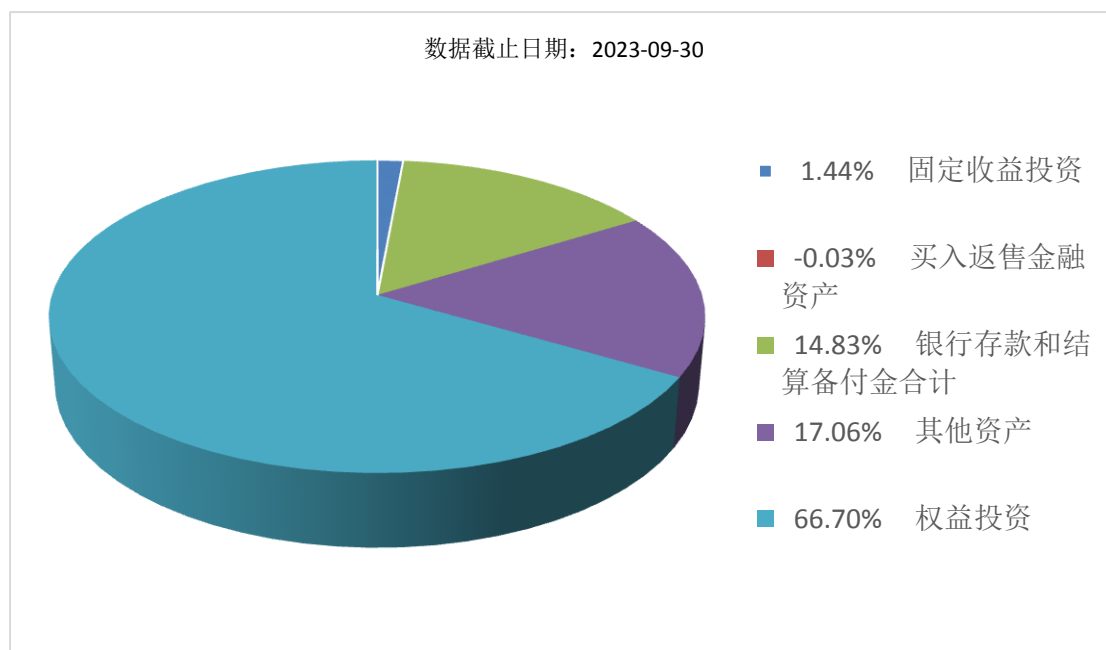
95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)

风险收益特征

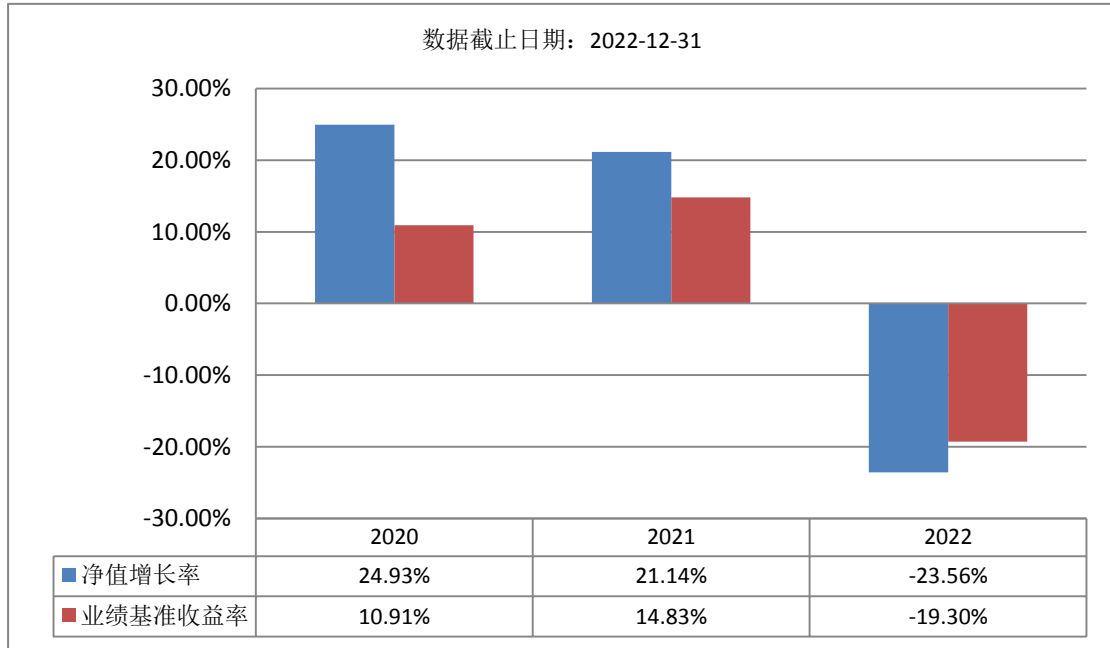
本基金为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金,通过跟踪标的指数表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注：原海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金于2020年3月5日转型为海富通中证500指数增强型证券投资基金。图中列示的2020年度基金净值增长率期间为2020年3月5日至2020年12月31日止。

基金的过往业绩不代表未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

三、投资本基金涉及的费用

（一）基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

费用类型	份额 (S) 或金额 (M) /持有期限 (N)	收费方式/费率	备注
申购费（前收费）	M < 100 万元	1.20%	非养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.80%	非养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.40%	非养老金客户
	M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔	非养老金客户
	M < 100 万元	0.30%	养老金客户
	100 万元 ≤ M < 200 万元	0.24%	养老金客户
	200 万元 ≤ M < 500 万元	0.16%	养老金客户
	M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔	养老金客户
赎回费	N < 7 天	1.50%	
	7 天 ≤ N < 30 天	0.75%	

30 天 \leq N < 180 天	0.50%
N \geq 180 天	-

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	固定费率 0.80%
托管费	固定费率 0.20%
基金标的 指数许可 使用费	固定费率 0.016%
其他费用	主要包括《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金的账户开户费用、账户维护费用及按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。该等费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

注：本基金指数许可使用费的收取下限为每自然季度5万元（大写：伍万元），计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

本基金费用的种类、计提标准和支付方式详见本基金的《招募说明书》。本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

投资于本基金的主要风险：

（一）本基金特有的风险

1、基金组合回报与标的指数回报偏离的风险

2、标的指数变更的风险

如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

3、指数增强型策略风险

根据本基金的投资策略，为了获得超越指数的投资回报，本基金可在参考标的指数成份股在指数中的权重比例构建基本投资组合，在基于数量化投资分析及基本面研究等方法对投资组合进行优化，以争取实现指数增强型的目标；存在因分析方法或主观判断失误，而不能达成指数增强型的风险。

4、标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而可能使得基金收益水平发生变化，产生风险。

5、跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

6、成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

7、指数编制机构停止服务的风险

8、基金合同终止的风险

9、基金投资存托凭证的风险

本基金投资存托凭证在承担境内上市交易股票投资的共同风险外，还将承担与存托凭证、创新企业发行、境外发行人以及交易机制相关的特有风险。

(二) 市场风险：1. 政策风险。2. 经济周期风险。3. 利率风险。4. 上市公司经营风险。5. 购买力风险。(三) 信用风险；(四) 管理风险；(五) 流动性风险；(六) 操作和技术风险；(七) 合规性风险；(八) 收益率曲线风险；(九) 杠杆放大风险；(十) 资产支持证券风险；(十一) 股指期货风险；(十二) 投资流通受限证券的风险；(十三) 国债期货风险；(十四) 本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险；(十五) 其他风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金的变更注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

与本基金/基金合同相关的争议解决方式为仲裁。因本基金产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方有权根据基金合同的约定提交至仲裁机构进行仲裁。具体仲裁机构和仲裁地点详见本基金合同的具体约定。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见海富通基金管理有限公司网站 (<http://www.hftfund.com>) (客服电话：40088-40099)。

- 本基金基金合同、托管协议、招募说明书
- 本基金定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 本基金基金份额净值
- 本基金基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料